



TITLE:

27号表紙

AUTHOR(S):

---

CITATION:

27号表紙. 調査と研究 : 経済論叢別冊 2003, 27

ISSUE DATE:

2003-10

URL:

<http://hdl.handle.net/2433/44559>

RIGHT:

経済論叢別冊

# 調査と研究

第27号

2003年10月

特集 金融工学のフロンティア

マルチンゲール法による最適消費／ ポートフォリオ選択問題の解法.....	岩 城 秀 樹 吉 川 大 介	1
VaR のバイアスと内挿・外挿による修正 .....	乾 孝 治	19
債券市場におけるリスクプレミアムの分解.....	今 井 俊 夫	27
ポートフォリオの信用リスク計測モデル ——シミュレーションと解析的手法の融合——.....	室 町 幸 雄	43
フィルタリングと変分法を用いた Kyle モデルの分析 .....	西 出 勝 正	53
独占市場におけるリアル・オプション分析 ——解析的アプローチ——.....	芝 田 隆 志 藤 原 哉	59

京 都 大 学 経 済 学 会